

Fecha de Publicación: 23 de Abril de 2010
Fecha de Información: 21 de Abril de 2010¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$784 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	89.1	145.6	20.0	10.0	85.6	39.1	194.6
15-35	233.3	247.8	163.5	33.0	27.3	143.3	424.1
36-60	68.9	20.8	0.0	0.0	0.8	48.9	69.8
61-90	3.8	3.1	0.0	0.0	3.1	3.8	6.9
91-180	82.3	20.8	0.0	50.0	0.8	12.3	83.1
>180	0.7	4.2	0.0	0.0	4.2	0.7	4.9
Total	478.1	442.4	183.5	93.0	121.9	248.1	783.5

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.0 %	0.5 %	1.3 %	0.6 %
15-35	1.2 %	1.5 %	-0.3 %	0.6 %
36-60	1.3 %	1.0 %	1.1 %	1.2 %
61-90	-	1.9 %	0.7 %	1.2 %
91-180	1.9 %	2.8 %	2.2 %	2.0 %
>180	-	5.4 %	2.9 %	5.0 %
Total	1.0 %	1.2 %	0.3 %	0.8 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	19 al 23 de Abril				26 al 30 de Abril				3 al 7 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	60	1525	1408	14	166	1900	1842	7	174	1204	1650
Intragruppo y off-shore***	0	0	827	391	0	0	878	257	0	0	953	414
Otros	60	19	349	902	166	14	465	1144	174	7	380	473
Total	79	79	2701	2701	181	181	3242	3242	181	181	2537	2537

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo